

	No. Alumni Universitas :	VENNY HAYATUNNOFUS	No. Alumni Fakultas :
	a) Tempat/Tanggal Lahir: Tanjung Pinang / 11 September 1994 b) Nama Orang Tua: Mulyadi Zubir dan Restiani c) Fakultas: Ekonomi d) Jurusan: Manajemen e) No. BP :1210522014 f) Tanggal Lulus: 29 Juli 2016 g) Predikat Lulus: Sangat Memuaskan h) IPK: 3,34 i) Lama Studi : 3 tahun 10 bulan j) Alamat Orang Tua: Simpang Bendang, Nagari Kinari, Kabupaten Solok		

**ANALISIS REAKSI PASAR MODAL YANG DITINJAU DARI PERUBAHAN
ABNORMAL RETURN, TRADING VOLUME ACTIVITY, DAN SECURITY
RETURN VARIABILITY SEBELUM DAN SESUDAH PERISTIWA
LEDAKAN BOM SARINAH**

ABSTRAK

Skrripsi S1 oleh Venny Hayatunnofus Pembimbing : Masyhuri Hamidi, SE,M.Si.Ph.D

Penelitian ini bertujuan untuk mengetahui reaksi pasar modal sebelum dan sesudah peristiwa ledakan bom Sarinah. Objek penelitian adalah saham-saham *Jakarta Islamic Index* dengan jumlah sampel sebanyak 27 saham yang dipilih berdasarkan metode *purposive sampling*. Penelitian ini menggunakan metode *event study* dengan melakukan pengujian hipotesis uji beda variabel *abnormal return* dengan menggunakan *paired t test* dan variabel *trading volume activity*, *security return variability* menggunakan *wilcoxon signed rank test*. Hasil penelitian menunjukkan bahwa *abnormal return*, *trading volume activity*, dan *security return variability* tidak ditemukan adanya perbedaan pada sebelum dan sesudah peristiwa ledakan bom Sarinah. Hasil ini diindikasikan dikarenakan peristiwa ledakan bom bukan kali pertama terjadi di Indonesia dan adanya pengumuman penurunan BI Rate menjadi alasan tidak terdapat perbedaan sebelum dan sesudah peristiwa ledakan bom Sarinah.

Kata Kunci : Reaksi Pasar, Abnormal Return, Trading Volume Activity, Security Return Variability, Ledakan Bom Sarinah

Skrripsi ini dipertahankan di depan sidang pengujian dan dinyatakan lulus pada tanggal 28 Juli 2016.

Abstrak ini telah disetujui oleh pembimbing dan penguji :

Tanda Tangan				
Nama Terang	Masyhuri Hamidi, SE,M.Si.Ph.D	Mohammad Fany Alfari, SE.,M.Fin	Venny Darlis, SE.,MRM	Sari Surya, SE.,MM

Mengetahui :
Ketua Jurusan

Dr. Vera Pujani, SE, MM. Tech
NIP. 19661115 200003 2 001

TandaTangan

Alumnus telah mendaftar ke Fakultas/Universitas dan mendapat nomor alumnus :

	Petugas Fakultas / Universitas	
No. Alumni Fakultas :	Nama	Tanda Tangan :
No. Alumni Universitas :	Nama	Tanda Tangan :

